

华夏蓝筹核心混合型证券投资基金(LOF)

2018年第四季度报告

基金管理人：华夏基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一九年一月二十一日
重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2019年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前请仔细阅读本部分的“风险揭示”章节。

本基金合同中约定的费率和费用在44页。

本报告期自2018年10月1日起至2018年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 华夏蓝筹混合(LOF)

基金代码 160211

基金运作方式 契约型开放式

上市地 上海证券交易所

基金管理人 华夏基金管理有限公司

基金托管人 交通银行股份有限公司

报告期末基金资产净值 2,002,205,540.00

投资目标 追踪标的指数，追求基金资产的长期稳定增值。

本基金将综合运用宏观分析、行业分析、公司基本面分析等方法，通过定性与定量相结合的分析，精选具有持续竞争优势且估值合理的股票，构建股票投资组合。

投资策略 在充分研究的基础上，通过定性与定量相结合的分析，精选具有持续竞争优势且估值合理的股票，构建股票投资组合。

业绩基准 业绩基准：沪深300指数×80%+中证国债指数×20%

风险收益特征 风险收益特征：股票型基金

基金经理 王华伟

报告期末基金份额总额 2,002,205,540.00

报告期末基金资产净值 2,002,205,540.00

报告期末基金份额净值 1.000

报告期净值增长率 -1.72%

报告期净值增长率标准差 1.09%

报告期期间最大回撤 -2.35%

报告期夏普比率 0.05

报告期詹森系数 0.00%

报告期特雷纳系数 1.00%

报告期收益率 1.00%

报告期跟踪偏离度 -0.04%

报告期跟踪误差 0.47%

报告期跟踪误差标准差 0.47%

报告期信息比率 1.22%

报告期夏普比率标准差 0.62%

报告期詹森系数标准差 0.10%

报告期特雷纳系数标准差 0.10%

报告期收益率标准差 0.04%

报告期跟踪偏离度标准差 0.04%

报告期跟踪误差标准差 0.04%

报告期信息比率标准差 0.04%

报告期夏普比率历史走势 -1.72%

报告期詹森系数历史走势 -0.04%

报告期特雷纳系数历史走势 -0.04%

报告期收益率历史走势 -0.04%

报告期跟踪偏离度历史走势 -0.04%

报告期跟踪误差历史走势 -0.04%

报告期信息比率历史走势 -0.04%

报告期夏普比率历史走势 -0.04%

报告期詹森系数历史走势 -0.04%

报告期特雷纳系数历史走势 -0.04%

报告期收益率历史走势 -0.04%

报告期跟踪偏离度历史走势 -0.04%

报告期跟踪误差历史走势 -0.04%

报告期信息比率历史走势 -0.04%

报告期夏普比率历史走势 -0.04%

报告期詹森系数历史走势 -0.04%

报告期特雷纳系数历史走势 -0.04%

报告期收益率历史走势 -0.04%

报告期跟踪偏离度历史走势 -0.04%

报告期跟踪误差历史走势 -0.04%

报告期信息比率历史走势 -0.04%

报告期夏普比率历史走势 -0.04%

报告期詹森系数历史走势 -0.04%

报告期特雷纳系数历史走势 -0.04%

报告期收益率历史走势 -0.04%

报告期跟踪偏离度历史走势 -0.04%

报告期跟踪误差历史走势 -0.04%

报告期信息比率历史走势 -0.04%

报告期夏普比率历史走势 -0.04%

报告期詹森系数历史走势 -0.04%

报告期特雷纳系数历史走势 -0.04%

报告期收益率历史走势 -0.04%

报告期跟踪偏离度历史走势 -0.04%

报告期跟踪误差历史走势 -0.04%

报告期信息比率历史走势 -0.04%

报告期夏普比率历史走势 -0.04%

报告期詹森系数历史走势 -0.04%

报告期特雷纳系数历史走势 -0.04%

报告期收益率历史走势 -0.04%

报告期跟踪偏离度历史走势 -0.04%

报告期跟踪误差历史走势 -0.04%

报告期信息比率历史走势 -0.04%

报告期夏普比率历史走势 -0.04%

报告期詹森系数历史走势 -0.04%

报告期特雷纳系数历史走势 -0.04%

报告期收益率历史走势 -0.04%

报告期跟踪偏离度历史走势 -0.04%

报告期跟踪误差历史走势 -0.04%

报告期信息比率历史走势 -0.04%

报告期夏普比率历史走势 -0.04%

报告期詹森系数历史走势 -0.04%

报告期特雷纳系数历史走势 -0.04%

报告期收益率历史走势 -0.04%

报告期跟踪偏离度历史走势 -0.04%

报告期跟踪误差历史走势 -0.04%

报告期信息比率历史走势 -0.04%

报告期夏普比率历史走势 -0.04%

报告期詹森系数历史走势 -0.04%

报告期特雷纳系数历史走势 -0.04%

报告期收益率历史走势 -0.04%

报告期跟踪偏离度历史走势 -0.04%

报告期跟踪误差历史走势 -0.04%

报告期信息比率历史走势 -0.04%

报告期夏普比率历史走势 -0.04%

报告期詹森系数历史走势 -0.04%

报告期特雷纳系数历史走势 -0.04%

报告期收益率历史走势 -0.04%

报告期跟踪偏离度历史走势 -0.04%

报告期跟踪误差历史走势 -0.04%

报告期信息比率历史走势 -0.04%

报告期夏普比率历史走势 -0.04%

报告期詹森系数历史走势 -0.04%

报告期特雷纳系数历史走势 -0.04%

报告期收益率历史走势 -0.04%

报告期跟踪偏离度历史走势 -0.04%

报告期跟踪误差历史走势 -0.04%

报告期信息比率历史走势 -0.04%

报告期夏普比率历史走势 -0.04%

报告期詹森系数历史走势 -0.04%

报告期特雷纳系数历史走势 -0.04%

报告期收益率历史走势 -0.04%

报告期跟踪偏离度历史走势 -0.04%

报告期跟踪误差历史走势 -0.04%

报告期信息比率历史走势 -0.04%

报告期夏普比率历史走势 -0.04%

报告期詹森系数历史走势 -0.04%

报告期特雷纳系数历史走势 -0.04%

报告期收益率历史走势 -0.04%

报告期跟踪偏离度历史走势 -0.04%

报告期跟踪误差历史走势 -0.04%

报告期信息比率历史走势 -0.04%

报告期夏普比率历史走势 -0.04%

报告期詹森系数历史走势 -0.04%

报告期特雷纳系数历史走势 -0.04%

报告期收益率历史走势 -0.04%

报告期跟踪偏离度历史走势 -0.04%

报告期跟踪误差历史走势 -0.04%

报告期信息比率历史走势 -0.04%

报告期夏普比率历史走势 -0.04%

报告期詹森系数历史走势 -0.04%

报告期特雷纳系数历史走势 -0.04%

报告期收益率历史走势 -0.04%

报告期跟踪偏离度历史走势 -0.04%

报告期跟踪误差历史走势 -0.04%

报告期信息比率历史走势 -0.04%

报告期夏普比率历史走势 -0.04%

报告期詹森系数历史走势 -0.04%

报告期特雷纳系数历史走势 -0.04%

报告期收益率历史走势 -0.04%

报告期跟踪偏离度历史走势 -0.04%

报告期跟踪误差历史走势 -0.04%

报告期信息比率历史走势 -0.04%

报告期夏普比率历史走势 -0.04%

报告期詹森系数历史走势 -0.04%

报告期特雷纳系数历史走势 -0.04%

报告期收益率历史走势 -0.04%

报告期跟踪偏离度历史走势 -0.04%

报告期跟踪误差历史走势 -0.04%

报告期信息比率历史走势 -0.04%

报告期夏普比率历史走势 -0.04%

报告期詹森系数历史走势 -0.04%

报告期特雷纳系数历史走势 -0.04%